

股票型基金			成立时间	2004-08-27
上海证券评级	综合评级	选证能力	择时能力	风控能力
3年	★★★★★	★★★★★	★★★★★	★★★★★
5年	★★★★★	★★★★★	★★★★★	★★★★★
基金经理		周炜炜	任职时间	2014-01-09

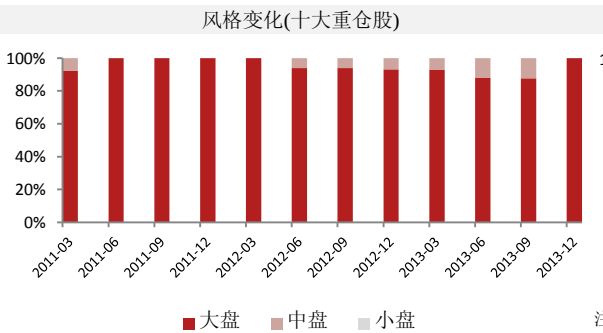
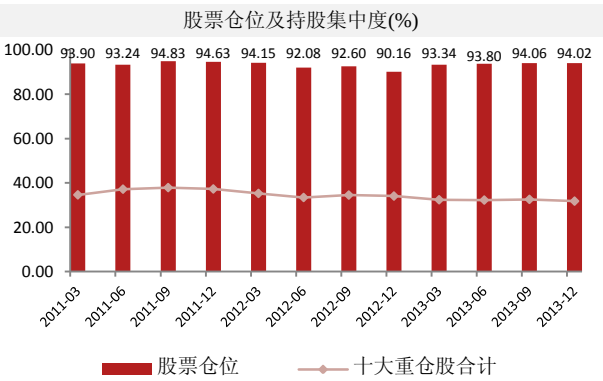
CFA，伦敦商学院金融学硕士。2002年至2006年任职于招商基金公司，历任招商先锋基金基金经理、基金管理部副总监；2006年至2010年10月任职于交银施罗德基金公司，历任交银施罗德成长股票基金基金经理、权益投资部总经理、投资副总监；2010年11月加入光大保德信基金公司，先后担任投资部首席投资总监，兼光大保德信优势配置股票型基金、光大保德信量化核心基金基金经理。

基金公司
光大保德信基金管理有限公司
投资策略

专注基本面研究，采取“自下而上”的策略，运用工银瑞信上市公司成长性评价体系选择具有长期可持续成长能力的上市公司股票。通过成长型股票，以合理价格买入并进行中长期投资，力争实现获取超过市场平均水平的长期投资收益的目标。

业绩基准
富时中国A200指数*90%+同业存款利率*10%

业绩表现 (截至时间：2013-12-31)			
单位净值(元)	累积收益率	资产规模(亿)	份额(亿份)
0.89	200.30%	90.73	102.30
风险收益指标	基金	基准	与同类比较
贝塔(股市)	0.9454	0.8720	
夏普比率	0.0134	-0.1001	较高
三年年化收益率	-1.12%	-7.93%	
三年年化波动率	21.12%	18.87%	较高
资产配置 (截至时间：2013-12-31)			



2008	2009	2010	2011	2012	2013	年度回报
-64.75%	90.61%	-3.20%	-21.07%	8.31%	13.07%	基金
-61.73%	78.64%	-11.73%	-21.83%	8.56%	-8.02%	基准
3月	6月	1年	2年	3年	5年	基金回报
-0.50%	16.68%	13.07%	22.47%	-3.34%	78.36%	基金
-2.97%	4.79%	-8.02%	-0.15%	-21.95%	23.08%	基准
-2.81%	10.51%	17.31%	23.12%	-8.29%	59.75%	同类

上证观点

光大量化核心基金采取量化投资策略，固定在高仓位运作，熊市的下跌风险较大，大盘上涨时能取得突出的回报，基金在2010年以来的震荡行情下优势不明显，但短期的波段行情中仍有较强表现。基金历史上仓位长期固定在94%左右，保持对股票资产的充分配置。股票投资长期重配金融、交通运输等低估值板块，同时多样化分散投资于其他多个行业，长期配置结构和风格较为稳定。其中金融行业配置比例长期20%以上。基金持股以大中盘低估值股票为主，兼顾成长股票，持股数量众多、投资分散。2013年基金适度增大对成长股的投资，风格较以往更灵活，取得了一定的正回报。四季度基金净值仅微跌，表现优于基准和同类股基。

基金经理观点：时间是检验投资能力的试金石。传统的投资品、周期股、消费品的观念一定程度上被电子信息、生物医药、节能环保等新兴成长的投资思路颠覆。为量化投资方向选择带来新课题，寻找真成长、新蓝筹将成为未来的前进目标。

2013-12重仓股	比重(%)	2013-9重仓股	比重(%)	行业（占净值比）	2013-12	2013-9
中国太保	4.77	兴业银行	6.95	农、林、牧、渔业	0.61	0.97
兴业银行	4.76	中国太保	4.22	采矿业	1.34	1.65
海南航空	3.54	海南航空	3.69	制造业	36.30	34.56
浦发银行	3.37	浦发银行	3.56	电力、热力、燃气及水生	6.58	5.02
国投电力	3.24	上汽集团	3.27	产和供应业		
上海机场	2.68	上海机场	2.79	建筑业	1.34	1.02
平安银行	2.42	国投电力	2.13	批发和零售业	3.91	4.61
上汽集团	2.34	亿城股份	2.06	交通运输、仓	7.43	7.54
广汇能源	2.34	广汇能源	1.97	储和邮政业		
华城汽车	2.34	华平股份	1.95	住宿和餐饮业		0.07
总持股比重	31.80	总持股比重	32.59	信息传输、软件和信息技术服务业	6.43	5.93
				金融业	19.82	21.97
				房地产业	4.79	6.15
				租赁和商务服务业	0.49	0.31
				科学研究和技术服务业	0.00	0.01
				水利、环境和公共设施管理	1.84	1.40
				居民服务、修理和其他服务业		
				教育		
				卫生和社会工作	0.55	0.63
				文化、体育和娱乐业	0.05	
				综合	2.53	2.21

注：行业变化系数指每季度增仓行业的累积总百分比
2013-03基金按最新行业分类披露，不做变化系数统计